

Fecha de Publicación: 13 de agosto de 2014

Fecha de Información: 11 de agosto de 2014¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$855,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	226,2	213,2	77,9	115,0	39,2	15,2	96,0
15-35	325,4	149,1	81,0	172,7	8,1	92,7	60,0
36-60	29,9	7,8	0,0	0,0	7,8	29,9	0,0
61-90	3,6	13,6	5,0	0,0	8,6	3,6	0,0
91-180	0,0	17,8	0,0	0,0	17,8	0,0	0,0
>180	17,1	7,8	0,0	15,0	7,8	2,1	0,0
Total	602,2	409,3	164,0	302,7	89,4	143,4	156,0

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	3,1 %	4,3 %	3,2 %	3,6 %
15-35	3,9 %	3,9 %	3,7 %	3,8 %
36-60	-	4,5 %	3,7 %	3,9 %
61-90	-	4,6 %	4,0 %	4,4 %
91-180	-	4,7 %	-	4,7 %
>180	-	4,4 %	4,0 %	4,2 %
Total	3,4 %	4,2 %	3,6 %	3,8 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

**Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards**

Sectores	11 al 15 de agosto				18 al 22 de agosto				25 al 29 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	122	3317	3661	12	100	2569	2090	11	125	2196	2932
Intragruo y off-shore***	5	0	2202	854	0	0	1156	924	0	0	1581	503
Otros	116	25	611	1615	100	12	459	1171	125	11	782	1124
Total	146	146	6130	6130	112	112	4185	4185	136	136	4559	4559

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.